

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о владельце:

ФИО: Ястребов Олег Александрович

Должность: Ректор

Дата подписания: 06.05.2024 23:43:04

Уникальный программный ключ:

ca953a0120d891083f939673078ef1a989dae18a

**Федеральное государственное автономное образовательное учреждение высшего образования**

**«Российский университет дружбы народов имени Патриса Лумумбы»**

**Институт мировой экономики и бизнеса**

(наименование основного учебного подразделения (ОУП)-разработчика ОП ВО)

## **РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ**

### **МЕЖДУНАРОДНОЕ УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ**

(наименование дисциплины/модуля)

**Рекомендована МССН для направления подготовки/специальности:**

### **38.04.01 ЭКОНОМИКА**

(код и наименование направления подготовки/специальности)

**Освоение дисциплины ведется в рамках реализации основной профессиональной образовательной программы высшего образования (ОП ВО):**

### **МЕЖДУНАРОДНЫЕ ФИНАНСЫ И БИЗНЕС**

(наименование (профиль/специализация) ОП ВО)

**2024 г.**

## 1. ЦЕЛЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Дисциплина «Международное управление рисками» входит в программу магистратуры «Международные финансы и бизнес» по направлению 38.04.01 «Экономика» и изучается в 3 семестре 2 курса. Дисциплину реализует Институт мировой экономики и бизнеса. Дисциплина состоит из 5 разделов и 14 тем и направлена на изучение различных подходов к управлению рисками

Целью освоения дисциплины является обеспечение углубленного изучения основных понятий риск-менеджмента в контексте международного бизнеса или проекта, обеспечение изучения и применения лучших международных практик и методов идентификации и анализа рисков, формирование базы знаний, позволяющей принимать сбалансированные инвестиционные/кредитные/ управленческие решения с учетом фактора риска.

## 2. ТРЕБОВАНИЯ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Освоение дисциплины «Международное управление рисками» направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций (части компетенций):

*Таблица 2.1. Перечень компетенций, формируемых у обучающихся при освоении дисциплины (результаты освоения дисциплины)*

Шифр	Компетенция	Индикаторы достижения компетенции (в рамках данной дисциплины)
УК-2	Способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла	УК-2.1 Формулирует проблему, решение которой напрямую связано с достижением цели проекта; УК-2.2 Определяет связи между поставленными задачами и ожидаемые результаты их решения; УК-2.3 В рамках поставленных задач определяет имеющиеся ресурсы и ограничения, действующие правовые нормы; УК-2.4 Анализирует план-график реализации проекта в целом и выбирает оптимальный способ решения поставленных задач, исходя из действующих правовых норм и имеющихся ресурсов и ограничений; УК-2.5 Контролирует ход выполнения проекта, корректирует план-график в соответствии с результатами контроля;
ОПК-4	Способен принимать экономически и финансово обоснованные организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности и нести за них ответственность	ОПК-4.1 Разрабатывает организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности; ОПК-4.2 Владеет навыками аргументированного убеждения в поддержку предлагаемых финансово-экономических и организационно-управленческих решений; ОПК-4.3 Контролирует результаты выполнения принимаемых финансово-экономических и организационно-управленческих решений;
ПК-1	Способен организовать работу по внешнеэкономической деятельности	ПК-1.1 Умеет анализировать и систематизировать внешнеэкономическую информацию; ПК-1.2 Владеет навыками ведения переговоров и знает особенности международных коммуникаций; ПК-1.3 Владеет навыками оценки бизнеса и управление рисками;
ПК-6	Способен выявлять бизнес-проблемы и бизнес-возможности	ПК-6.1 Собирает информацию о бизнес-проблемах или бизнес-возможностях; ПК-6.2 Использует техники выявления бизнес-проблем и бизнес-возможностей; ПК-6.3 Определяет связи и зависимости между элементами информации бизнес-анализа и принимает обоснованные решения для достижения целевых показателей;

## 3. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОП ВО

Дисциплина «Международное управление рисками» относится к обязательной части блока 1 «Дисциплины (модули)» образовательной программы высшего образования.

В рамках образовательной программы высшего образования обучающиеся также осваивают другие дисциплины и/или практики, способствующие достижению запланированных результатов освоения дисциплины «Международное управление рисками».

Таблица 3.1. Перечень компонентов ОП ВО, способствующих достижению запланированных результатов освоения дисциплины

Шифр	Наименование компетенции	Предшествующие дисциплины/модули, практики*	Последующие дисциплины/модули, практики*
УК-2	Способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла	Ознакомительная практика; Научно-исследовательская работа; Международный банкинг; Организация международных закупок; Международный маркетинг;	Преддипломная практика;
ОПК-4	Способен принимать экономически и финансово обоснованные организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности и нести за них ответственность	Ознакомительная практика; Математические методы в международных финансах и бизнесе; <i>Искусство международных переговоров**</i> ; Международные коммерческие операции;	Преддипломная практика;
ПК-1	Способен организовать работу по внешнеэкономической деятельности	Организация международных закупок; <i>Искусство международных переговоров**</i> ;	Преддипломная практика;
ПК-6	Способен выявлять бизнес-проблемы и бизнес-возможности	<i>Agile**</i> ; <i>Environmental, Social, and Corporate Governance (ESG)**</i> ; <i>Искусство международных переговоров**</i> ; <i>Кросс-культурный маркетинг**</i> ;	Преддипломная практика;

\* - заполняется в соответствии с матрицей компетенций и СУП ОП ВО

\*\* - элективные дисциплины /практики

#### 4. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ И ВИДЫ УЧЕБНОЙ РАБОТЫ

Общая трудоемкость дисциплины «Международное управление рисками» составляет «3» зачетные единицы.

Таблица 4.1. Виды учебной работы по периодам освоения образовательной программы высшего образования для очной формы обучения.

Вид учебной работы	ВСЕГО, ак.ч.		Семестр(-ы)
			3
<i>Контактная работа, ак.ч.</i>	34		34
Лекции (ЛК)	17		17
Лабораторные работы (ЛР)	0		0
Практические/семинарские занятия (СЗ)	17		17
<i>Самостоятельная работа обучающихся, ак.ч.</i>	47		47
<i>Контроль (экзамен/зачет с оценкой), ак.ч.</i>	27		27
<b>Общая трудоемкость дисциплины</b>	<b>ак.ч.</b>	<b>108</b>	<b>108</b>
	<b>зач.ед.</b>	<b>3</b>	<b>3</b>

## 5. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Таблица 5.1. Содержание дисциплины (модуля) по видам учебной работы

Номер раздела	Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела (темы)		Вид учебной работы*
Раздел 1	Основы риск-менеджмента	1.1	Понятие риска и содержание риск-менеджмента. Экономические риски. Оценка риска.	ЛК, СЗ
		1.2	Виды рисков. Матрица рисков.	ЛК, СЗ
		1.3	Методы управления рисками. Основные принципы классификации рисков. Управление рисками коммерческого банка. Интегрированный риск-менеджмент	ЛК, СЗ
Раздел 2	Классификация рисков	2.1	Кредитные риски и финансовые риски. Базельские соглашения.	ЛК, СЗ
		2.2	Управление процентным риском.	ЛК, СЗ
		2.3	Управление валютным риском	ЛК, СЗ
Раздел 3	Методы анализа, оценки и управления рисками	3.1	Методы анализа рисков. Инструментарий анализа рисков. Качественный и количественный анализ рисков. Анализ рыночных рисков.	ЛК, СЗ
		3.2	Управление операционным риском	ЛК, СЗ
		3.3	Практика оценки кредитного риска международными рейтинговыми агентствами и финансовыми институтами. Финансовое моделирование и планирование для целей оценки риска.	ЛК, СЗ
Раздел 4	Риски международной компании или проекта	4.1	Понятие суверенного (странового) риска.	ЛК, СЗ
		4.2	Практическое использование методов оценки кредитного риска при принятии инвестиционного/кредитного решения международной кредитной организацией.	ЛК, СЗ
Раздел 5	Управление рисками международной компании или проекта	5.1	Управление политическими рисками в зарубежной коммерческой деятельности и международной банковской деятельности.	ЛК, СЗ
		5.2	Методы хеджирования политических, валютных и процентных рисков. Управление рыночными (ценовыми) рисками.	ЛК, СЗ
		5.3	ESG-риски. Риск технологий. Модельный риск.	ЛК, СЗ

\* - заполняется только по **ОЧНОЙ** форме обучения: ЛК – лекции; ЛР – лабораторные работы; СЗ – практически/семинарские занятия.

## 6. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Таблица 6.1. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Тип аудитории	Оснащение аудитории	Специализированное учебное/лабораторное оборудование, ПО и материалы для освоения дисциплины (при необходимости)
Лекционная	Аудитория для проведения занятий лекционного типа, оснащенная комплектом специализированной мебели; доской (экраном) и техническими средствами мультимедиа презентаций.	
Семинарская	Аудитория для проведения занятий	

	семинарского типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, оснащенная комплектом специализированной мебели и техническими средствами мультимедиа презентаций.	
Для самостоятельной работы	Аудитория для самостоятельной работы обучающихся (может использоваться для проведения семинарских занятий и консультаций), оснащенная комплектом специализированной мебели и компьютерами с доступом в ЭИОС.	

\* - аудитория для самостоятельной работы обучающихся указывается **ОБЯЗАТЕЛЬНО!**

## 7. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

### *Основная литература:*

1. Michel Crouhy, Dan Galai and Robert Mark, The Essentials of Risk Management, 2nd Edition (New York: McGraw- Hill, 2014).
2. Blaise Ganguin, John Bilardello, Standard & Poor's Fundamentals of Corporate Credit Analysis, 1 edition (New York: McGraw-Hill, 2004).
3. Гусаков Николай Павлович. Международные валютно-кредитные отношения [Электронный ресурс] : Учебник / Н.П. Гусаков, И.Н. Белова, М.А. Стренина; Под общ. ред. Н.П. Гусакова. - 2-е изд., перераб. и доп. ; Электронные текстовые данные. - М. : ИНФРА-М, 2015. - 314 с.

### *Дополнительная литература:*

1. Arnold Ziegel. Fundamentals of Credit and Credit Analysis: Corporate Credit Analysis (CreateSpace Independent Publishing Platform, 2015)
2. Jonathan Golin and Philippe Delhaise, The Bank Credit Analysis Handbook, 2nd Edition (Hoboken, NJ: John Wiley & Sons, 2013).
3. Eugene F. Brigham, Michael C. Ehrhardt, Financial Management: Theory & Practice, 14th Edition (South-Western College Pub, 2013).
4. Michael E. Porter, Competitive Strategy: Techniques for Analyzing Industries and Competitors, 1st Edition (Free Press, 1998).
5. Allan Malz, Financial Risk Management: Models, History, and Institutions (Hoboken, NJ: John Wiley & Sons, 2011).
6. Jon Gregory, Counterparty Credit Risk and Credit Value Adjustment: A Continuing Challenge for Global Financial Markets, 2nd Edition (West Sussex, UK: John Wiley & Sons, 2012).
7. Karen P. Schoenebeck, Mark P. Holtzman, Interpreting and Analyzing Financial Statements, 6th Edition (Prentice Hall, 2012).
8. Brealey R., Myers S., Allen F. Principles of Corporate Finance (Finance, Insurance, and Real Estate). McGraw-Hill/Irwin – 2010, 968 pages, 10th Edition
9. В. Бочаров. Финансовый анализ. Краткий курс. 2-е изд. СПб.: 2009. — 240 с.
10. Loan Market Assentation (LMA) newsletter and regular publications (<http://www.lma.eu.com/news-publications/lma-guides>).
11. the Global Association of Risk Professionals (GARP, <https://www.garp.org/#!/frm/study-materials>) or the Professional Risk Managers' International Association (PRMIA, <http://www.prmia.org/prm-exam/handbook>).

### *Ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»:*

1. ЭБС РУДН и сторонние ЭБС, к которым студенты университета имеют доступ

на основании заключенных договоров

- Электронно-библиотечная система РУДН – ЭБС РУДН

<http://lib.rudn.ru/MegaPro/Web>

- ЭБС «Университетская библиотека онлайн» <http://www.biblioclub.ru>
- ЭБС Юрайт <http://www.biblio-online.ru>
- ЭБС «Консультант студента» [www.studentlibrary.ru](http://www.studentlibrary.ru)
- ЭБС «Троицкий мост»

## 2. Базы данных и поисковые системы

- электронный фонд правовой и нормативно-технической документации

<http://docs.cntd.ru/>

- поисковая система Яндекс <https://www.yandex.ru/>
- поисковая система Google <https://www.google.ru/>
- реферативная база данных SCOPUS

<http://www.elsevierscience.ru/products/scopus/>

- <https://www.garp.org/> - Global Association of Risk Professionals (GARP)
- <http://www.prmia.org/> - Professional Risk Managers' International Association

(PRMIA)

- [www.imf.org](http://www.imf.org) – Официальный сайт Международного валютного фонда
- [www.bis.org](http://www.bis.org) – Официальный сайт Банка международных расчетов
- [www.worldbank.org](http://www.worldbank.org) – Официальный сайт Всемирного банка
- [www.nyse.com](http://www.nyse.com) - Нью-Йоркская фондовая биржа
- [www.nasdaq.com](http://www.nasdaq.com) – Фондовый рынок Nasdaq
- [www.londonstockexchange.com](http://www.londonstockexchange.com) - Лондонская фондовая биржа
- <http://www.ved.gov.ru> - Министерство экономического развития

Российской Федерации, Портал Внешнеэкономической деятельности

- [www.wto.org](http://www.wto.org) – Официальный сайт Всемирной торговой организации
- <http://journals.cambridge.org/action> - база данных зарубежных журналов по соответствующей тематике

- <https://www.world-exchanges.org/> - Всемирная федерация бирж
- [www.gks.ru](http://www.gks.ru) – официальный сайт Федеральной службы государственной

статистики РФ.

- [www.budgetrf.ru](http://www.budgetrf.ru) – мониторинг экономических показателей.
- [www.minfin.ru](http://www.minfin.ru) – официальный сайт Министерства финансов РФ
- [www.rbc.ru](http://www.rbc.ru) - официальный сайт компании РосБизнесКонсалтинг
- [www.cbr.ru](http://www.cbr.ru) – официальный сайт Банка России.

*Учебно-методические материалы для самостоятельной работы обучающихся при освоении дисциплины/модуля\*:*

1. Курс лекций по дисциплине «Международное управление рисками».

\* - все учебно-методические материалы для самостоятельной работы обучающихся размещаются в соответствии с действующим порядком на странице дисциплины **в ТУИС!**

## **8. ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ И БАЛЛЬНО-РЕЙТИНГОВАЯ СИСТЕМА ОЦЕНИВАНИЯ УРОВНЯ СФОРМИРОВАННОСТИ КОМПЕТЕНЦИЙ ПО ДИСЦИПЛИНЕ**

Оценочные материалы и балльно-рейтинговая система\* оценивания уровня сформированности компетенций (части компетенций) по итогам освоения дисциплины «Международное управление рисками» представлены в Приложении к настоящей Рабочей программе дисциплины.

\* - ОМ и БРС формируются на основании требований соответствующего локального нормативного акта РУДН.



**РАЗРАБОТЧИК:**

ассистент кафедры МЭО

*Должность, БУП*

*Подпись*

Миновска Мила

*Фамилия И.О.*

**РУКОВОДИТЕЛЬ БУП:**

*Должность БУП*

*Подпись*

*Фамилия И.О.*

**РУКОВОДИТЕЛЬ ОП ВО:**

Доцент

*Должность, БУП*

*Подпись*

Соколан Дарья Сергеевна

*Фамилия И.О.*